

ภาคผนวก ก

ผลการทดสอบ Ascending Stochastic Dominance ด้วยวิธี DD-Test

ตารางที่ ก.1

แสดงผลการทดสอบ ASD ด้วยวิธี DD-Test ที่ระดับนัยสำคัญ 0.1

ตลาดหลักทรัพย์	%Test Statistic					
	FASD		SASD		TASD	
	%T>0	%T<0	%T>0	%T<0	%T>0	%T<0
HANGSENG VS KOSPI50	1	0	0	0	0	0
HANGSENG VS NIKKEI225	0	0	0	0	0	0
HANGSENG VS SET50	0	25	0	0	0	0
HANGSENG VS STRAITS TIMES	15	17	81	0	48	0
HANGSENG VS TSEC50	0	10	0	0	0	0
KOSPI50 VS NIKKEI225	0	1	0	0	0	0
KOSPI50 VS SET50	0	12	0	0	0	0
KOSPI50 VS STRAITS TIMES	25	35	77	0	88	0
KOSPI50 VS TSEC50	0	0	0	0	0	0
NIKKEI225 VS SET50	0	0	0	0	0	0
NIKKEI225 VS STRAITS TIMES	24	19	75	0	78	0
NIKKEI225 VS TSEC50	0	1	0	0	0	0
SET50 VS STRAITS TIMES	49	27	84	0	21	0
SET50 VS TSEC50	0	0	0	0	0	0
STRAITS TIMES VS TSEC50	23	29	0	88	0	88

## ตารางที่ ก.2

แสดงผลการทดสอบ ASD ด้วยวิธี DD-Test ที่ระดับนัยสำคัญ 0.05

ตลาดหลักทรัพย์	%Test Statistic					
	FASD		SASD		TASD	
	%T>0	%T<0	%T>0	%T<0	%T>0	%T<0
HANGSENG VS KOSPI50	0	0	0	0	0	0
HANGSENG VS NIKKEI225	0	0	0	0	0	0
HANGSENG VS SET50	0	22	0	0	0	0
HANGSENG VS STRAITS TIMES	15	17	78	0	30	0
HANGSENG VS TSEC50	0	8	0	0	0	0
KOSPI50 VS NIKKEI225	0	0	0	0	0	0
KOSPI50 VS SET50	0	2	0	0	0	0
KOSPI50 VS STRAITS TIMES	22	33	74	0	86	0
KOSPI50 VS TSEC50	0	0	0	0	0	0
NIKKEI225 VS SET50	0	0	0	0	0	0
NIKKEI225 VS STRAITS TIMES	22	18	73	0	72	0
NIKKEI225 VS TSEC50	0	0	0	0	0	0
SET50 VS STRAITS TIMES	47	26	82	0	9	0
SET50 VS TSEC50	0	0	0	0	0	0
STRAITS TIMES VS TSEC50	23	28	0	86	0	87

## ตารางที่ ก.3

แสดงผลการทดสอบ ASD ด้วยวิธี DD-Test ที่ระดับนัยสำคัญ 0.01

ตลาดหลักทรัพย์	%Test Statistic					
	FASD		SASD		TASD	
	%T>0	%T<0	%T>0	%T<0	%T>0	%T<0
HANGSENG VS KOSPI50	0	0	0	0	0	0
HANGSENG VS NIKKEI225	0	0	0	0	0	0
HANGSENG VS SET50	0	17	0	0	0	0
HANGSENG VS STRAITS TIMES	9	15	72	0	0	0
HANGSENG VS TSEC50	0	2	0	0	0	0
KOSPI50 VS NIKKEI225	0	0	0	0	0	0
KOSPI50 VS SET50	0	0	0	0	0	0
KOSPI50 VS STRAITS TIMES	19	30	70	0	81	0
KOSPI50 VS TSEC50	0	0	0	0	0	0
NIKKEI225 VS SET50	0	0	0	0	0	0
NIKKEI225 VS STRAITS TIMES	16	17	65	0	54	0
NIKKEI225 VS TSEC50	0	0	0	0	0	0
SET50 VS STRAITS TIMES	39	23	77	0	0	0
SET50 VS TSEC50	0	0	0	0	0	0
STRAITS TIMES VS TSEC50	20	24	0	82	0	81